



Karta przedmiotu
Portfel inwestycyjny

1. Informacje podstawowe

| | | |
|---|---|---------------------------------|
| Kierunek studiów finanse i rachunkowość Specjalność - Jednostka zarządzająca kierunkiem studiów Wydział Zarządzania Poziom studiów drugiego stopnia (mgr) Profil studiów Profil praktyczny Forma studiów studia niestacjonarne | Cykl kształcenia (nabór) 2024/25 Kod przedmiotu 08FIR-PN.DM2C.3290.24 Języki wykładowe polski Obligatoryjność Fakultatywny Blok zajęciowy Przedmioty kierunkowe | |
| Wymagania wstępne | brak | |
| Przedmioty wprowadzające | brak | |
| Koordinator | Zbigniew Drewniak | |
| Okres Semestr 2 | Forma i godziny zajęć <ul style="list-style-type: none">Wykład: 10, EgzaminĆwiczenia audytoryjne: 10, Zaliczenie na ocenęĆwiczenia laboratoryjne: 10, Zaliczenie na ocenę | Liczba punktów ECTS 3 |

2. Efekty uczenia się dla przedmiotu

| Kod | Opis efektów uczenia się | Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się | Odniesienie do charakterystyk PRK |
|-----|--------------------------|---|-----------------------------------|
|-----|--------------------------|---|-----------------------------------|

| Kod | Opis efektów uczenia się | Odniesienie do kierunkowych efektów uczenia się | Odniesienie do charakterystyk PRK |
|-------------------------------|---|---|-----------------------------------|
| Wiedza: | | | |
| W1 | Zna i rozumie w pogłębionym stopniu metody pomiaru dochodu i ryzyka instrumentu finansowego. | FIR_P2_K_W02 | P7S_WG |
| W2 | Zna i rozumie zasady budowy portfeli dwu- i wieloskładnikowych o minimalnym ryzyku i zakładanej stopie zwrotu. | FIR_P2_K_W05 | P7S_WG |
| Umiejętności: | | | |
| U1 | Potrafi wyznaczyć dochód oraz oszacować ryzyko inwestycji w dany instrument finansowy. | FIR_P2_K_U01 | P7S_UW |
| U2 | Potrafi skonstruować portfel dwu- i wieloskładnikowy. | FIR_P2_K_U07 | P7S_UW |
| Kompetencje społeczne: | | | |
| K1 | Jest gotów wykorzystać wiedzę na temat podstaw budowy i zarządzania portfelem inwestycyjnym w podejmowaniu decyzji inwestycyjnych w sposób efektywny i etyczny. | FIR_P2_K_K04 | P7S_KR |

3. Treści programowe

| Lp. | Treści programowe | Formy zajęć | Efekty uczenia się dla przedmiotu |
|-----|--|--|-----------------------------------|
| 1. | Wykład Rynek finansowy i instrumenty rynku finansowego. Dochód instrumentu finansowego. Stopa zwrotu i średnia stopa zwrotu. Korelacja stóp zwrotu. Ćwiczenia audytoryjne Zadania z zakresu pomiaru dochodu instrumentu finansowego. Ćwiczenia laboratoryjne Źródła danych o notowaniach instrumentów finansowych, dobór spółek do portfela i wyznaczenie stopy zwrotu i średniej stopy zwrotu. | Wykład, Ćwiczenia audytoryjne, Ćwiczenia laboratoryjne | W1, U1, K1 |
| 2. | Wykład Ryzyko instrumentu finansowego - pojęcie, rodzaje i metody pomiaru. Ćwiczenia audytoryjne Zadania z zakresu mier ryzyka. Ćwiczenia laboratoryjne Wyznaczenie ryzyka analizowanych instrumentów finansowych. | Wykład, Ćwiczenia audytoryjne, Ćwiczenia laboratoryjne | W1, U1, K1 |
| 3. | Wykład Portfel dwuskładnikowy o minimalnym ryzyku, portfel dwuskładnikowy o zakładanej stopie zwrotu. Ćwiczenia audytoryjne Obliczanie ryzyka portfela dwuskładnikowego. Ćwiczenia laboratoryjne Budowa portfeli dwuskładnikowych o minimalnym ryzyku i zakładanej stopie zwrotu. | Wykład, Ćwiczenia audytoryjne, Ćwiczenia laboratoryjne | W2, U2, K1 |

| Lp. | Treści programowe | Formy zajęć | Efekty uczenia się dla przedmiotu |
|-----|--|--|-----------------------------------|
| 4. | Wykład Portfel wieloskładnikowy o minimalnym ryzyku, portfel wieloskładnikowy o zakładanej stopie zwrotu. Ćwiczenia audytoryjne Obliczanie ryzyka portfela wieloskładnikowego. Ćwiczenia laboratoryjne Budowa portfeli wieloskładnikowych o minimalnym ryzyku i zakładanej stopie zwrotu. | Wykład, Ćwiczenia audytoryjne, Ćwiczenia laboratoryjne | W2, U2, K1 |
| 5. | Wykład Portfel z uwzględnieniem instrumentów wolnych od ryzyka Ćwiczenia audytoryjne Zadania z zakresu portfeli z uwzględnieniem instrumentów wolnych od ryzyka. | Wykład, Ćwiczenia audytoryjne | W1, W2, U1, U2, K1 |

4. Metody prowadzenia zajęć, weryfikacji efektów uczenia się i warunki zaliczenia

| Forma zajęć | | |
|---|---|----------------|
| Wykład | Metody prowadzenia zajęć: | |
| | Wykład, Ćwiczenia laboratoryjne, Ćwiczenia rachunkowe | |
| | Metody (sposoby) weryfikacji: | Udział: |
| | Egzamin pisemny | 100% |
| | Warunki zaliczenia przedmiotu: | |
| Test składający się z pytania otwartego, pytań typu prawda/fałsz oraz pytań testowych. Możliwość uzyskania dodatkowych punktów za aktywność na zajęciach. | | |
| Ćwiczenia audytoryjne | Metody prowadzenia zajęć: | |
| | Ćwiczenia rachunkowe | |
| | Metody (sposoby) weryfikacji: | Udział: |
| | Kolokwium | 100% |
| | Warunki zaliczenia przedmiotu: | |
| Kolokwium składające się z zadań do rozwiązania. | | |
| Ćwiczenia laboratoryjne | Metody prowadzenia zajęć: | |
| | Projekt | |
| | Metody (sposoby) weryfikacji: | Udział: |
| | Projekt | 100% |
| | Warunki zaliczenia przedmiotu: | |
| Przygotowanie projektu polegającego na zbudowaniu portfela dwu- lub trzyskładnikowego. | | |

| Efekt uczenia się dla przedmiotu | Metody (sposoby) weryfikacji | | |
|----------------------------------|------------------------------|-----------|---------|
| | Egzamin pisemny | Kolokwium | Projekt |

| | | | |
|----|---|---|---|
| W1 | x | x | |
| W2 | x | x | |
| U1 | | x | x |
| U2 | | x | x |
| K1 | x | x | x |

5. Literatura

Literatura podstawowa

1. Czapiewski P. , Niedziółka P., 2016. Zarządzanie portfelem inwestycyjnym, Diffin.
2. Jajuga K., Jajuga T., 2015. Inwestycje. Instrumenty finansowe, ryzyko finansowe, Inżynieria finansowa, PWN.
3. Ostrowska E., 2014. Portfel inwestycyjny klasyczny i alternatywny, C.H. Beck.
4. Capiński M.J., Kopp E., 2014. Portfolio Theory and Risk Management, Cambridge University Press.

Literatura uzupełniająca

1. Borowski K., 2014. Miary ryzyka na rynku akcji i obligacji, Diffin.
2. Reilly F., Brown K., 2001. Analiza inwestycji i zarządzanie portfelem, PWE.

6. Nakład pracy studenta - bilans godzin i punktów ECTS

| Aktywność studenta | | Obciążenie studenta Liczba godzin |
|---|---------------------------|--------------------------------------|
| Zajęcia prowadzone z bezpośrednim udziałem nauczyciela akademickiego lub innych osób prowadzących zajęcia | Wykład | 10 |
| | Ćwiczenia audytoryjne | 10 |
| | Ćwiczenia laboratoryjne | 10 |
| Praca własna studenta | Konsultacje | 10 |
| | Przygotowanie do zajęć | 10 |
| | Przygotowanie projektu | 20 |
| | Przygotowanie do egzaminu | 10 |
| | Studiowanie literatury | 10 |
| Łączny nakład pracy studenta | | 90 |
| Liczba punktów ECTS | | 3 |

* Godzina (dydaktyczna) oznacza 45 minut